

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ РЕСПУБЛИКИ БЕЛАРУСЬ

БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

**ГОСУДАРСТВЕННЫЙ ИНСТИТУТ УПРАВЛЕНИЯ
И СОЦИАЛЬНЫХ ТЕХНОЛОГИЙ**

Кафедра управления финансами

ЛУКАШЕВИЧ

Илья Витальевич

**ОЦЕНКА ЭФФЕКТИВНОСТИ УПРАВЛЕНИЯ ИНВЕСТИЦИОННОГО
ПОРТФЕЛЯ**

Дипломная работа

Научный руководитель:
кандидат экономических наук,
доцент А.Ю. Семенов

Допущена к защите

«___»_____2015 г.

Зав. кафедрой управления финансами

кандидат экономических наук, доцент

_____ М.Л. Зеленкевич

Минск, 2015

РЕФЕРАТ

Объем дипломной работы составляет 72 страницы. Работа содержит 23 рисунка, 6 таблиц, 4 приложения. При написании дипломной работы использовано 51 источник.

ИНВЕСТИЦИОННЫЙ ПОРТФЕЛЬ, ДОХОДНОСТЬ, РИСК, МОДЕЛЬ МАРКОВИЦА, СТРАТЕГИЯ УПРАВЛЕНИЯ, ДИВЕРСИФИКАЦИЯ ПОРТФЕЛЯ, ЦЕННЫЕ БУМАГИ, ФОНДОВАЯ БИРЖА.

Несмотря на широкий спектр проведенных работ в портфельной теории остались неизученными некоторые аспекты моделирования процесса принятия решений, особенно связанные с оценкой эффективности управления инвестиционного портфеля.

Цель дипломной работы: оценить эффективность управления инвестиционного портфеля на примере «Приорбанк» ОАО.

Объектом исследования является управление инвестиционного портфеля субъекта хозяйствования.

Предметом исследования выступает эффективность управления инвестиционным портфелем «Приорбанк» ОАО.

Дипломная работа состоит из трех глав, введения, заключения и приложений.

ABSTRACT

The volume of the graduate work is 72 pages. The work contains 23 figures, 6 tables, 4 appendix. When writing a work used 51 source.

INVESTMENT PORTFOLIO, PROFITABILITY, RISK, MARKOWITZ MODEL, MANAGEMENT STRATEGY OF PORTFOLIO DIVERSIFICATION, SECURITIES, STOCK EXCHANGE

Despite the wide range of the works in portfolio theory remain unexplored, some aspects of modeling decision-making process, especially related to the assessment of efficiency of management of the investment portfolio.

The purpose of the graduate work: to evaluate the effectiveness of management of the investment portfolio as an example of "Priorbank".

The research object of the graduate work is the management of the investment portfolio of a business entity.

The subject of research is the efficiency of portfolio management "Priorbank". Graduate work of three chapters, introduction, conclusion, and appendix.

РЭФЕРАТ

Аб'ём дыпломнай працы складае 72 старонкі. Праца змяшчае 23 малюнка, 6 табліц, 4 дадаткі. Пры напісанні дыпломнай працы выкарыстана 51 крыніца.

**ІНВЕСТИЦЫЙНЫ ПАРТФЕЛЬ, ДАХОДНАСЦЬ, РЫЗЫКА, МАДЭЛЬ
МАРКОВІЦА, СТРАТЭГІІ КІРАВАННЯ, ДЫВЕРСІФІКАЦЫІ ПАРТФЕЛЯ,
КАШТОЎНЫЯ ПАПЕРЫ, ФОНДАВЫЯ БІРЖЫ**

Нягледзячы на шырокі спектр праведзенных работ у партфельнай тэорыі засталіся нявывучанымі некаторыя аспекты мадэлявання працэсу прыняцця рашэнняў, асабліва звязаныя з ацэнкай эфектыўнасці кіравання інвестыцыйнага партфеля.

Мэта дыпломнай працы: ацаніць эфектыўнасць кіравання інвестыцыйнага партфеля на прыкладзе «Прыорбанк» ААТ.

Аб'ектам даследавання з'яўляецца кіраванне інвестыцыйнага партфеля суб'екта гаспадарання.

Прадметам даследавання выступае эфектыўнасць кіравання інвестыцыйным партфелем «Прыорбанк» ААТ.

Дыпломная праца складаецца з трох глаў, уводзін, заключэння, дадаткаў.